

Plan 246 Lic. en Economía

Asignatura 43708 MODELOS ECONOMETRICOS

Grupo 1

Presentación

Complementos al Modelo de Regresión Múltiple y al Modelo de Ecuaciones Simultáneas. Series Temporales. Utilización de paquetes econométricos para ordenadores.

Programa Básico

Objetivos

Al finalizar el curso el alumno debe ser capaz de:

- Comprender los elementos básicos que caracterizan un modelo econométrico que incluye regresores estocásticos.
- Comprender los elementos básicos que caracterizan un modelo dinámico, considerando el problema de las relaciones espúrias en economía.
- Comprender los elementos básicos que caracterizan un modelo econométrico multiecuacional.
- Conocer y manejar los procedimientos del programa informático Eviews para aplicarlos en el contexto de los modelos anteriores.
- Interpretar de forma crítica los resultados obtenidos.

Programa de Teoría

Los ejercicios prácticos corresponden a los temas incluidos en el programa de teoría y se realizan mediante el programa informático EViews.

Programa Práctico

Evaluación

BIBLIOGRAFÍA

- Alcaide, A. y otros (2001): "Aplicaciones Econométricas" UNED, Madrid.
- Álvarez, N. ((2001): "Econometría II: Análisis de modelos econométricos de series temporales" AC, Madrid.
- Andrés, J., Escribano, A., Molinas, C. y Taguas, D.: "La inversión en España. Econometría con restricciones de equilibrio" Antoni Bosch editor. Instituto de Estudios Fiscales. Barcelona, 1990.
- Aznar, A. y F.J. Trívez. " Métodos de Predicción en Economía II. Análisis de Series Temporales" Ed. Ariel Economía.
- Banerjee, A., Dolado, J., Galbraith, J. y Hendry, D.: "Co-Integration, Error-Correction, and the Econometric Analysis of Non-Stationary Data" Oxford University Press, New York, 1994.
- Caridad , J. M.: " Econometría: Modelos Econométricos y Series Temporales con los paquetes microTSP y TSP. Tomo 2: Modelos Econométricos Multiecuacionales, Predicción Económica y Series Temporales ". Ed. Reverté. Barcelona, 1998.
- Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000): Análisis Econométrico con Eviews. Ed. Rama

Cuadernos Económicos de ICE, Nº 44, 1990/1: "Cointegración y raíces unitarias: Un área en crecimiento" (coordinado por Álvaro Escribano).

Davidson, R. y Mackinnon, J. G. (1993): "Estimation and Inference in Econometrics". Oxford University Press, New York.

Greene, W. H.: "Análisis Económico". Prentice Hall. Madrid, 1999.

Hendry, D.: "The Structure of Simultaneous Equations Estimators". Journal of Econometrics. 1976.

Schmidt, P.: "Econometrics". Marcel Dekker. New York, 1976.

Johnston, J.: "Métodos de Econometría". Vicens-Vives. Barcelona, 1989.

Johnston, J. y Dinardo, J. (2001): "Métodos de Econometría" Vicens Vives.

Novalés, A.: "Econometría". Mc Graw Hill. Madrid, 1993.

Otero, J.: "Econometría. Series temporales y predicción" AC, 1993.

Pena, B. y otros (1999). Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L.: "Econometría. Modelos y pronósticos". McGraw-Hill, Madrid, 2001.

Ramanathan, R. (1998): "Introductory Econometrics with Applications" Dryden Press, USA.

Sánchez, C.: "Métodos Económicos". Ariel. Barcelona, 1999.

Theil, H.: "Principles of Econometrics". Wiley. New York, 1971.

Wooldridge, J. (2001): "Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno". Paraninfo Thomson Learning, Madrid.

BIBLIOGRAFÍA REDUCIDA PARA LA ASIGNATURA

Teoría:

Davidson, R. y Mackinnon, J. G. (1993): "Estimation and Inference in Econometrics". Oxford University Press, New York.

Greene, W. H. (1999): "Análisis Económico". Prentice Hall. Madrid.

Johnston, J. y Dinardo, J. (2001): "Métodos de Econometría" Vicens Vives.

Novalés, A (1993): "Econometría". Mc Graw Hill. Madrid.

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L. (2001): "Econometría. Modelos y pronósticos". McGraw-Hill, Madrid.

Wooldridge, J. (2001): "Introducción a la Econometría. Un enfoque moderno". Paraninfo Thomson Learning, Madrid.

Práctica

Alcaide, A. y otros (2001): "Aplicaciones Económicas" UNED, Madrid.

Caridad, J. M. (1998): "Econometría: Modelos Económicos y Series Temporales con los paquetes microTSP y TSP. Tomo 2: Modelos Económicos Multiecuacionales, Predicción Económica y Series Temporales". Ed. Reverté. Barcelona.

Carrascal, U., González, Y. y Rodríguez, B. (2000): Análisis Económico con Eviews. Ed. Rama

Pena, B. y otros (1999). Cien Ejercicios de Econometría. Ed. Pirámide

Pindyck, R. S. And Rubinfeld, D. L. (2001): "Econometría. Modelos y pronósticos". McGraw-Hill, Madrid.

Ramanathan, R. (1998): "Introductory Econometrics with Applications" Dryden Press, USA.

Bibliografía

True
